

# 银河创新成长混合型证券投资基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本基金自 2015 年 7 月 17 日起由股票型变更为混合型，基金更名为“银河创新成长混合型证券投资基金”，相应修改了基金的风险收益特征、基金合同和托管协议相关条款，并在指定媒体上公告。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	银河创新混合
场内简称	-
基金主代码	519674
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 29 日
基金管理人	银河基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	475, 508, 850. 24 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有良好成长性的创新类上市公司，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用自上而下的资产配置与自下而上的股票选择相结合。在资产配置策略上，本基金根据对经济面、政策面、市场面等多因素分析，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票和债券的比例。在股票选择上，本基金主要投资于具有创新能力和持续增长潜力的上市公司股票，力争为基金份额持有人带来长期、稳定的资本增值。
业绩比较基准	业绩基准收益率=中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		银河基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	董伯儒	张燕
	联系电话	021-38568888	0755-83199084
	电子邮箱	dongboru@galaxyasset.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-820-0860	95555
传真		021-38568769	0755-83195201

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.galaxyasset.com">http://www.galaxyasset.com</a>
基金年度报告备置地点	1、上海市世纪大道 1568 号中建大厦 15 楼 2、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	532,420,223.31	192,352,771.82	355,332,473.15
本期利润	610,318,244.16	146,110,899.30	332,914,205.18
加权平均基金份额本期利润	1.2130	0.2267	0.3982
本期基金份额净值增长率	62.61%	18.84%	38.84%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	1.5678	0.6057	0.2788
期末基金资产净值	1,241,614,491.72	747,805,465.52	1,144,523,943.56
期末基金份额净值	2.6111	1.6057	1.3511

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

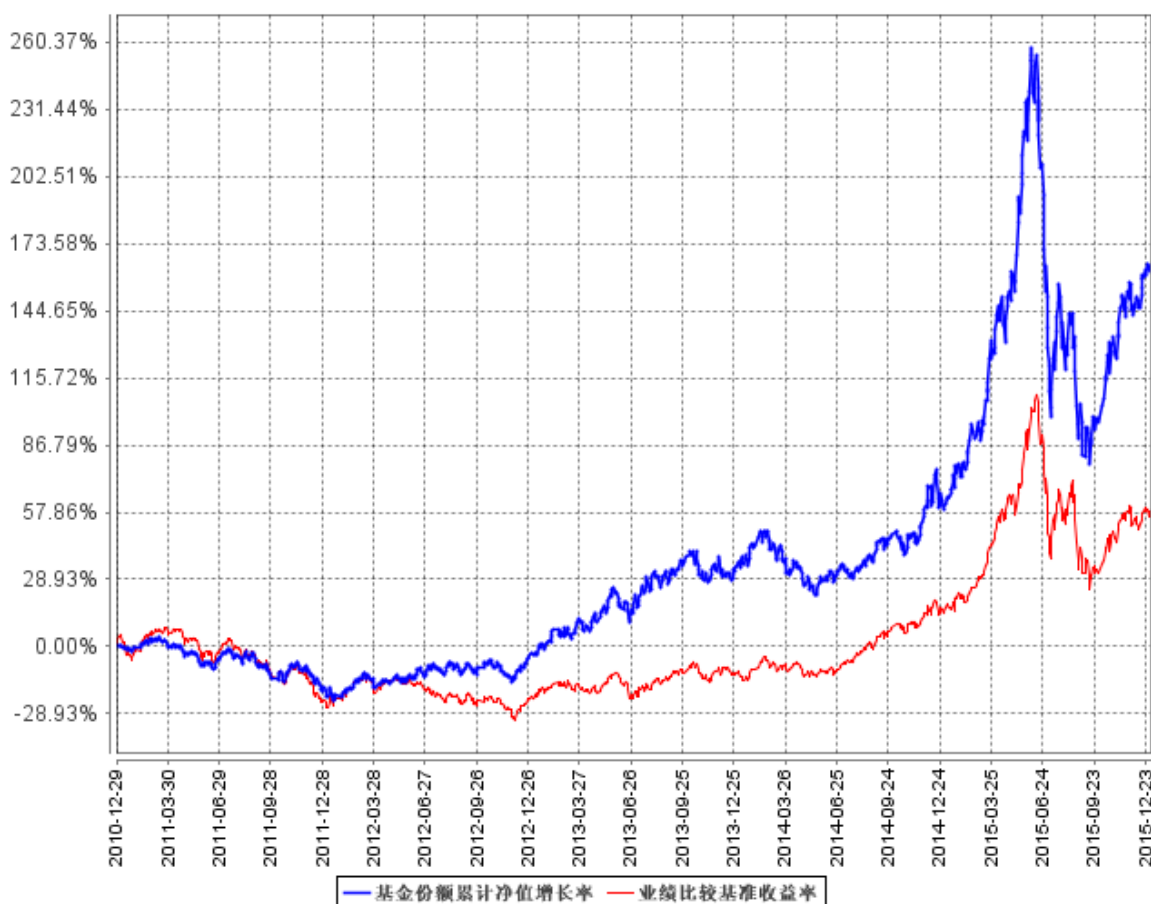
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	32.66%	1.90%	18.64%	1.54%	14.02%	0.36%
过去六个月	-1.03%	2.89%	-9.21%	2.43%	8.18%	0.46%
过去一年	62.61%	2.72%	35.28%	2.11%	27.33%	0.61%
过去三年	168.33%	1.92%	99.79%	1.47%	68.54%	0.45%
过去五年	161.11%	1.62%	51.22%	1.35%	109.89%	0.27%
自基金合同生效起至今	161.11%	1.62%	56.15%	1.35%	104.96%	0.27%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%，每日进行再平衡过程。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

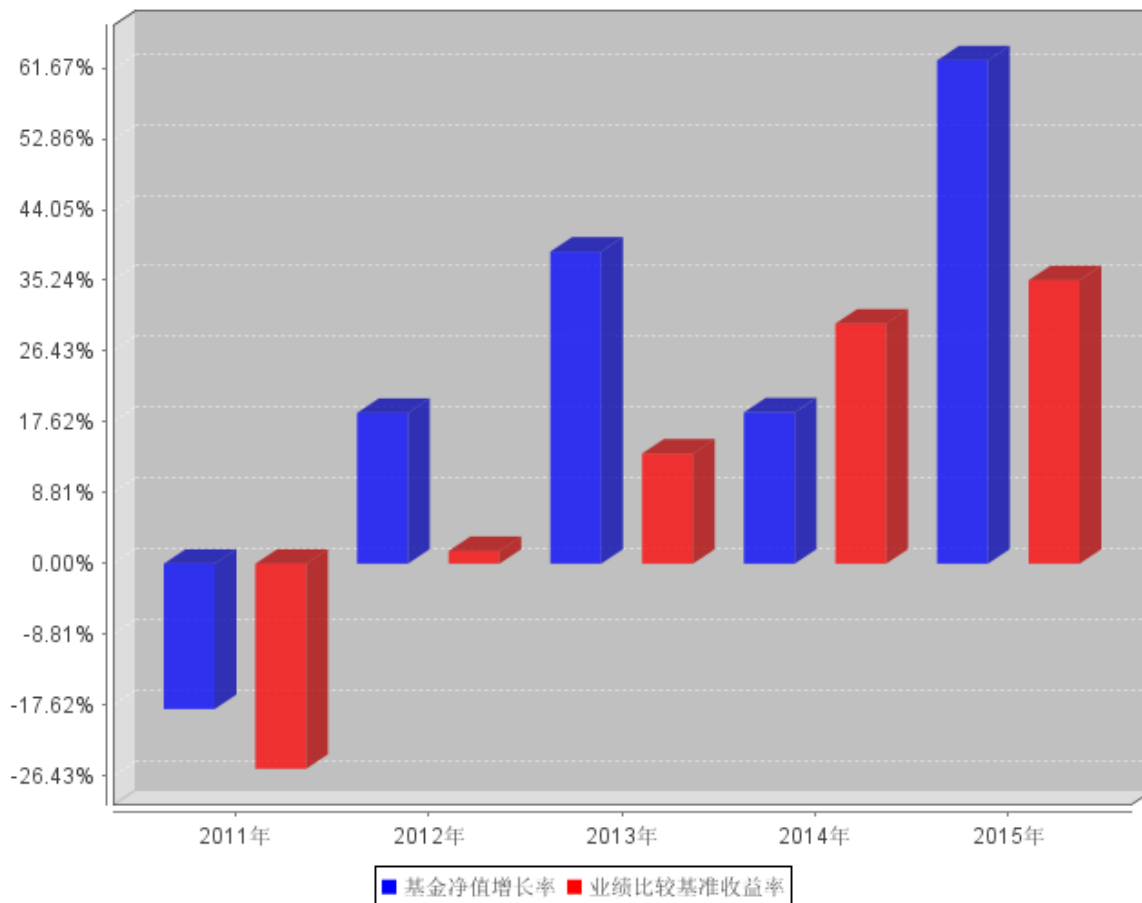


注：本基金合同于 2010 年 12 月 29 日生效，根据本基金合同规定，本基金应自基金合同生效日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定：本基金投资的股票资产占基金资产的 60%—95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%—40%，现金或者到期日在一年以内

的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金合同于 2010 年 12 月 29 日生效，本基金三年内未分配利润。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司设立于 2002 年 6 月 14 日，公司的股东分别为中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限

公司、湖南电广传媒股份有限公司。

目前，除本基金外，银河基金管理有限公司另管理 1 只封闭式基金与 26 只开放式证券投资基金，基本情况如下：

#### 1、银丰证券投资基金

类型：契约型封闭式

成立日：2002 年 8 月 15 日

投资目标：为平衡型基金，力求有机融合稳健型和进取型两种投资风格，在控制风险的前提下追求基金资产的长期稳定增值。

#### 2、银河银联系列证券投资基金

本系列基金为契约型开放式基金，由两只基金构成，包括银河稳健证券投资基金和银河收益证券投资基金，每只基金彼此独立运作，并通过基金间相互转换构成一个统一的基金体系。

基金合同生效日：2003 年 8 月 4 日

##### (1) 银河稳健证券投资基金

基金投资目标：以稳健的投资风格，构造资本增值与收益水平适度匹配的投资组合，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

##### (2) 银河收益证券投资基金

基金投资目标：以债券投资为主，兼顾股票投资，在充分控制风险和保持较高流动性的前提下，实现基金资产的安全及长期稳定增值。

#### 3、银河银泰理财分红证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 3 月 30 日

基金投资目标：追求资产的安全性和流动性，为投资者创造长期稳定的投资回报

#### 4、银河银富货币市场基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2004 年 12 月 20 日

基金投资目标：在确保基金资产安全和高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的回报。

#### 5、银河银信添利债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007 年 3 月 14 日

基金投资目标：在满足本金稳妥与良好流动性的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

6、银河竞争优势成长混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2008 年 5 月 26 日

基金投资目标：在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

7、银河行业优选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 4 月 24 日

基金投资目标： 本基金将“自上而下”的资产配置以及动态行业配置策略与“自下而上”的个股优选策略相结合，优选景气行业或预期景气行业中的优势企业进行投资，在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，通过主动式管理，追求基金中长期资本增值。

8、银河沪深 300 价值指数证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009 年 12 月 28 日

基金投资目标：通过严格的投资程序约束、数学模型优化和跟踪误差控制模型等数量化风险管理手段，追求指数投资相对于业绩比较基准的跟踪误差的最小化。

9、银河蓝筹精选混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2010 年 7 月 16 日

基金投资目标：本基金投资于中国经济中具有代表性和竞争力的蓝筹公司，在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争使基金份额持有人分享中国经济持续成长的成果。

10、银河强化收益债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 5 月 31 日

基金投资目标：本基金主要投资于固定收益类品种，在控制风险，保持资产良好流动性的前提下，追求一定的当期收入和基金资产的长期稳健增值。

11、银河消费驱动混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011 年 7 月 29 日



基金投资目标：本基金通过深入研究，重点投资与居民消费密切相关的行业中具有竞争优势的上市公司，分享由于中国巨大的人口基数、收入增长和消费结构变革所带来的投资机会，在严格控制风险的前提下，追求基金资产长期稳定增值。

#### 12、银河通利债券型证券投资基金（LOF）

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 4 月 25 日

基金投资目标：在合理控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

#### 13、银河主题策略混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 9 月 21 日

基金投资目标：本基金在严格控制风险的前提下，采用主题投资策略和精选个股策略的方法进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 14、银河领先债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2012 年 11 月 29 日

基金投资目标：在合理控制风险的前提下，力求为基金份额持有人创造高于业绩比较基准的投资收益。

#### 15、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 3 月 29 日

基金投资目标：本基金为增强型股票指数基金，力求对沪深 300 成长指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。

#### 16、银河增利债券型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2013 年 7 月 17 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的具有投资价值的股票，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

#### 17、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式(本基金以定期开放的方式运作, 运作周期和自由开放期相结合, 以 1 年为一个运作周期, 每个运作周期共包含为 4 个封闭期和 3 个受限开放期)。

基金合同生效日：2013 年 8 月 9 日

基金投资目标：本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，通过严谨的风险管理与主动管理，力求实现基金资产持续稳定增值。

#### 18、银河灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 2 月 11 日

基金投资目标：本基金主要投资于股票等权益类资产和债券等固定收益类金融工具，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，在确保超越业绩比较基准、实现基金资产持续稳定增值的前提下，力求获取超额收益。

#### 19、银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014 年 3 月 14 日

基金投资目标：本基金为股票型指数基金，力求对中证腾安价值 100 指数进行有效跟踪，在严格控制跟踪偏离和跟踪误差的前提下追求跟踪误差的最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

#### 20、银河美丽优萃混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-05-29

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的美丽主题相关股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 21、银河润利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-08-06

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

#### 22、银河康乐股票型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014-11-18

基金投资目标：本基金主要投资于具有竞争优势的本基金定义的健康快乐主题相关的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 23、银河泽利保本混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-09

基金投资目标：本基金应用优化的恒定比例投资保险策略（优化的 CPPI 策略），并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。

#### 24、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-22

基金投资目标：本基金将充分把握中国经济可持续发展过程中现代服务主题相关行业及子行业呈现出的投资机会，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中现代服务主题相关行业及子行业的崛起所孕育的投资机遇。在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 25、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-04-22

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 26、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-05-12

基金投资目标：本基金将充分把握我国经济结构转型调整、产业结构优化升级等国家经济战略布局过程中呈现的转型增长主题投资机会，充分利用我公司的研究投资优势，通过行业配置和精选个股，分享中国在加快转变经济结构转型、产业优化升级的红利，在严格控制投资风险的前提下，力争基金资产获取超越业绩比较基准的稳健收益。

#### 27、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015-06-19

基金投资目标：本基金在合理控制风险的前提下，在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，分享中国在加快转变经济发展方式的过程中所孕育的投资机遇，追求实现基金资产的持续稳定增值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王培	银河创新成长混合型证券投资基金的基金经理、银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理、银河主题策略混合型证券投资基金的基金经理、股票投资部副总监	2011年6月3日	-	9	硕士研究生学历，曾就职于国泰君安证券股份有限公司研究所，从事石化化工行业的研究分析工作。2009年7月加入银河基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理等职务，2013年10月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理，2013年5月至2015年5月担任银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金的基金经理，2015年5月起担任银河主题策略混合型证券投资基金的基金经理，2015年6月起担任股票投资部副总监。

注：1. 上表中任职日期为公司决定之日，离职日期为对外公告之日。

2. 证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金份额持有人的利益，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳定的回报。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度，投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度，从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

在投资决策环节，公司实行统一研究平台和统一的授权管理，所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面，本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度，遵循“时间优先、价格优先”的原则，在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序，最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面，除法规规定的特殊情况外，公司原则上禁止不同投资组合（完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外）之间的同日反向交易。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保公平对待不同投资组合。同时，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行

了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，由各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年的市场跌宕起伏，也是本基金遇到的波动最大的市场，其中创业板指数表现尤为突出，全年上涨 84.8%，振幅达到了 177.3%，而 2014 年表现较好的主板则稍显乏力，全年上证综指上涨 9.4%，全年振幅也创出了近六年来的新高达到 72.0%。2015 年上半年，基本上处于疯牛的状态，在创新牛和改革牛的预期下，中小创的股票迭创新高，尤其是以“互联网+”为核心逻辑的创新型企业都出现了和 2000 年类似的互联网泡沫，在这种大浪潮下，投资者的心态和行为也出现了显著的变化，以至于在 6 月末出现了前所未有的股灾，而 A 股在几年加杠杆运行后，第一次出现了去杠杆行情，并一度出现了流动性危机。2015 年后期的市场基本上是以修复为主的，牛市的步伐基本宣告结束。

本基金在 2015 年大多数时间依然还是坚持过去几年的投资方向，侧重于软件、传媒、新兴消费等领域，由于上半年是新兴成长股的牛市，本基金涨幅较大，不过 6 月末股灾式调整幅度超出预期，虽然本基金选择了分散投资规避风险，不过也出现了非常大的回撤，一度下跌距离高点超过 50%，而随着下半年投资趋于理性，本基金在股灾后的投资上更注重基本面，因此修复期的表现尚可。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年基金净值增长率为 62.61%，基金业绩比较基准收益率为 35.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，需要投资者重新审视 A 股市场，而影响市场的几点因素又指向不一，需要更加精细的投资方法和更为准确和清晰的市场判断。

其一，高收益率资产匮乏，导致低估值品种获得溢价可能。4 季度保险公司举牌 A 股公司的方式，让很多投资者大跌眼镜，其时间短，力度大的风格也使得市场对低估值品种重新认识。这种现象在目前优质项目匮乏，而大量资产无处可去的时候，得到更为合理的解释。2016 年，这种趋势会愈演愈烈，这在演绎了多年中小创牛市后，出现的最大风格转换的可能变量，一旦经济企稳预期阶段性增加，这种低估值品种有可能会阶段性出现阶段性的行情，不可忽视。

其二，注册制短期影响有限，不过中长期看，炒小炒新和跨市场套利最终会无利可图。由于注册制稳步推行，再加上不断的重组和跨市场套利方式愈演愈烈，二级市场承受的压力空前，本基金判断 2016 年的市场依然和前几年比有本质上的差异，投资者更注重安全性和公司基本面，主题投资将变成非主流。

其三，股灾让绝对收益成为主流策略，必将增加股票波动。2015 年 6 月份的股灾让众多投资者损失惨重，而随着市场信心恢复，市场重新开始活跃。以银行资产池为重心的增量资金，大多风险承受度较低，而多数投资者一朝被蛇咬后，肯定会发生投资行为上的变化，这种变化会限制市场极度过高的热情，也进而导致二级市场的波动加大。

以上三点虽然不能完全总结 2016 年市场特征，不过大致上收益率预期较 2015 年下滑，投资机会不再完全集中在中小市值个股已经成为客观指向。谈到投资机会，A 股市场会迎来兑现的一年，更多讲盈利模式的公司不得不面临更为苛刻的验证阶段。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照新准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及基金合同的约定，制定了健全、有效的估值政策和程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了估值工作决策、监督、审查的专门部门，组成人员包括投资研究部门、监察稽核部门及会计核算部门的工作负责人或资深业务人员，其多数拥有十年以上的证券、风控、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。

同时不断建立起一套完整、有效的估值工作管理规定及程序，对估值相关的各个环节均配有专门的人员实施、把控，并保证环节的各方不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定：本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。

截止本报告期末，可分配收益为：745,503,616.38，本基金本报告期内未实施利润分配。



#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2016）审字第 60821717_B11 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	银河创新成长混合型证券投资基金(原名银河创新成长股票型证券投资基金)全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的银河创新成长混合型证券投资基金(原名银河创新成长股票型证券投资基金)财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表和2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人银河基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了银河创新成长混合型证券投资基金(原名银河创新成长股票型证券投资基金)2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	中国注册会计师郭杭翔	中国注册会计师濮晓达
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼	
审计报告日期	2016年3月23日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：银河创新成长混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		292,302,164.07	37,518,008.37
结算备付金		6,162,927.57	4,026,686.03
存出保证金		1,152,511.80	546,578.60
交易性金融资产		946,556,736.60	644,727,473.62
其中：股票投资		906,564,736.60	604,703,473.62
基金投资		-	-
债券投资		39,992,000.00	40,024,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		4,330,164.29	66,242,006.25
应收利息		298,882.39	1,054,808.33
应收股利		-	-
应收申购款		60,900.00	147,669.93
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,250,864,286.72	754,263,231.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,149,018.84	-
应付赎回款		799,890.16	1,608,311.97
应付管理人报酬		1,583,982.29	1,078,569.78
应付托管费		263,997.06	179,761.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,169,893.59	3,179,157.86

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		283,013.06	411,964.41
负债合计		9,249,795.00	6,457,765.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		475,508,850.24	465,709,849.33
未分配利润		766,105,641.48	282,095,616.19
所有者权益合计		1,241,614,491.72	747,805,465.52
负债和所有者权益总计		1,250,864,286.72	754,263,231.13

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6111 元，基金份额总额 475,508,850.24 份。

## 7.2 利润表

会计主体：银河创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		652,235,408.50	176,990,053.59
1. 利息收入		2,458,278.97	3,425,752.49
其中：存款利息收入		1,042,050.07	839,068.10
债券利息收入		1,416,228.90	1,780,073.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	806,610.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		571,238,587.86	218,562,625.52
其中：股票投资收益		568,438,092.76	213,127,790.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		300,522.05	145,750.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,499,973.05	5,289,085.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		77,898,020.85	-46,241,872.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）		640,520.82	1,243,548.10
<b>减：二、费用</b>		41,917,164.34	30,879,154.29
1. 管理人报酬		17,525,404.60	13,582,011.47
2. 托管费		2,920,900.77	2,263,668.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		21,000,974.77	14,549,697.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		469,884.20	483,776.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		610,318,244.16	146,110,899.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		610,318,244.16	146,110,899.30

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银河创新成长混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	465,709,849.33	282,095,616.19	747,805,465.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	610,318,244.16	610,318,244.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,799,000.91	-126,308,218.87	-116,509,217.96
其中：1. 基金申购款	394,974,717.49	465,786,823.76	860,761,541.25
2. 基金赎回款	-385,175,716.58	-592,095,042.63	-977,270,759.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	475,508,850.24	766,105,641.48	1,241,614,491.72
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	847,105,443.83	297,418,499.73	1,144,523,943.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	146,110,899.30	146,110,899.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-381,395,594.50	-161,433,782.84	-542,829,377.34
其中：1. 基金申购款	456,866,551.46	189,090,517.94	645,957,069.40
2. 基金赎回款	-838,262,145.96	-350,524,300.78	-1,188,786,446.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	465,709,849.33	282,095,616.19	747,805,465.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>陈勇</u>	<u>陈勇</u>	<u>秦长建</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

银河创新成长混合型证券投资基金（原名银河创新成长股票型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010]1635号《关于核准银河创新成长股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人银河基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2010年12月29日正式生效，首次设立募集规模为1,252,121,826.55份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，

基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金自 2015 年 7 月 17 日起更名为银河创新成长混合型证券投资基金。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资的股票资产占基金资产的 60%—95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%—40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金将不低于 80% 的股票资产投资于具有创新能力和成长潜力的上市公司。以后如有法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并依法进行投资管理。

本基金的业绩比较标准是：中证 500 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计估计的变更在 7.4.5.2 会计估计变更的说明中披露，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定,自2015年3月26日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、



红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司	基金管理人的第一大股东
中国石油天然气集团公司	基金管理人的股东
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司	受基金管理人第一大股东控制、基金代销机构

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
银河证券	1,041,940,483.71	7.53%	2,357,519,133.73	24.85%

##### 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
银河证券	-	-	340,000,000.00	7.06%

##### 7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
银河证券	953,802.26	7.64%	353,136.62	11.14%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
银河证券	2,095,190.09	24.68%	814,437.51	25.62%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,525,404.60	13,582,011.47
其中：支付销售机构的客户维护费	1,866,498.25	2,303,347.99

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,920,900.77	2,263,668.52

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	20,039,644.38	-	-	-	-	-

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	292,302,164.07	924,197.04	37,518,008.37	725,488.88

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	同方国芯	2015 年 12 月 11 日	筹划重大事项	60.15	2016 年 3 月 11 日	54.14	608,012	38,865,840.06	36,571,921.80	-
300011	鼎汉技术	2015 年 12 月 31 日	筹划重大事项	29.80	2016 年 1 月 22 日	26.82	699,947	17,924,591.23	20,858,420.60	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	筹划重大事项	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	350,000	11,927,001.00	10,937,500.00	-

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 838,196,894.20 元，属于第二层次的余额为人民币 108,359,842.40 元，无属于第三层次的余额。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 546,031,498.86 元，属于第二层次的余额为人民币 98,695,974.76 元，无属于第三层次的余额。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 26 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	906,564,736.60	72.48
	其中：股票	906,564,736.60	72.48
2	固定收益投资	39,992,000.00	3.20
	其中：债券	39,992,000.00	3.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	298,465,091.64	23.86
7	其他各项资产	5,842,458.48	0.47
8	合计	1,250,864,286.72	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	361,783,614.96	29.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	222,304.44	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	18,854,000.00	1.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	100,167,318.14	8.07
J	金融业	143,099,600.00	11.53
K	房地产业	109,644,354.08	8.83
L	租赁和商务服务业	87,972,987.90	7.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,369.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	84,818,187.48	6.83
S	综合	-	-
	合计	906,564,736.60	73.01

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	1,909,965	87,972,987.90	7.09
2	601166	兴业银行	5,000,000	85,350,000.00	6.87
3	002094	青岛金王	1,980,165	61,682,139.75	4.97
4	002113	天润控股	1,382,120	54,870,164.00	4.42
5	600340	华夏幸福	1,783,014	54,774,190.08	4.41
6	300113	顺网科技	470,497	47,694,280.89	3.84
7	600476	湘邮科技	1,199,857	47,094,387.25	3.79
8	603899	晨光文具	1,023,209	43,036,170.54	3.47
9	000793	华闻传媒	2,491,400	37,445,742.00	3.02
10	300078	思创医惠	749,880	36,594,144.00	2.95

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	190,843,976.37	25.52
2	600588	用友网络	127,875,562.91	17.10
3	600276	恒瑞医药	104,781,965.72	14.01
4	300104	乐视网	103,014,531.49	13.78



5	600570	恒生电子	100,038,571.14	13.38
6	600476	湘邮科技	99,641,170.64	13.32
7	002183	怡亚通	96,763,799.68	12.94
8	601318	中国平安	93,700,906.52	12.53
9	002250	联化科技	92,889,851.63	12.42
10	002405	四维图新	90,460,181.92	12.10
11	002439	启明星辰	89,279,042.15	11.94
12	601688	华泰证券	83,578,804.43	11.18
13	600999	招商证券	81,702,948.33	10.93
14	601628	中国人寿	80,382,580.06	10.75
15	000568	泸州老窖	79,311,370.09	10.61
16	002308	威创股份	79,169,551.94	10.59
17	603899	晨光文具	77,615,435.21	10.38
18	300059	东方财富	72,474,150.35	9.69
19	600048	保利地产	71,886,313.96	9.61
20	600029	南方航空	67,898,811.92	9.08
21	601169	北京银行	67,104,044.60	8.97
22	002292	奥飞动漫	65,614,700.27	8.77
23	002049	同方国芯	64,329,029.06	8.60
24	300348	长亮科技	60,301,286.54	8.06
25	601601	中国太保	59,730,703.87	7.99
26	002285	世联行	59,392,093.08	7.94
27	002466	天齐锂业	57,443,355.97	7.68
28	600061	国投安信	56,344,064.26	7.53
29	002094	青岛金王	56,226,235.73	7.52
30	000566	海南海药	54,530,501.40	7.29
31	600340	华夏幸福	50,818,087.40	6.80
32	002699	美盛文化	49,943,403.50	6.68
33	600958	东方证券	49,581,172.46	6.63
34	300113	顺网科技	49,209,632.25	6.58
35	002354	天神娱乐	48,070,113.07	6.43
36	002675	东诚药业	48,020,476.74	6.42
37	002135	东南网架	47,138,343.50	6.30
38	600109	国金证券	44,281,840.55	5.92
39	002714	牧原股份	43,918,755.96	5.87
40	000002	万科A	41,524,873.87	5.55

41	300043	互动娱乐	41,373,855.76	5.53
42	300392	腾信股份	40,701,726.80	5.44
43	601336	新华保险	40,358,787.97	5.40
44	002113	天润控股	39,303,330.62	5.26
45	002153	石基信息	38,741,702.94	5.18
46	300078	思创医惠	38,648,510.50	5.17
47	300329	海伦钢琴	38,187,661.70	5.11
48	002010	传化股份	37,975,239.27	5.08
49	002402	和而泰	37,817,108.00	5.06
50	300203	聚光科技	37,433,508.85	5.01
51	600787	中储股份	37,393,228.90	5.00
52	002717	岭南园林	37,312,378.17	4.99
53	300010	立思辰	37,266,873.59	4.98
54	603766	隆鑫通用	37,157,460.25	4.97
55	300016	北陆药业	36,877,743.57	4.93
56	000016	深康佳A	36,433,147.22	4.87
57	002572	索菲亚	36,406,976.82	4.87
58	002152	广电运通	35,754,832.15	4.78
59	600038	中直股份	35,633,860.68	4.77
60	600559	老白干酒	35,032,982.11	4.68
61	000411	英特集团	34,935,914.70	4.67
62	300244	迪安诊断	34,879,840.30	4.66
63	002400	省广股份	34,538,545.73	4.62
64	002462	嘉事堂	33,945,011.70	4.54
65	002658	雪迪龙	33,515,789.02	4.48
66	002380	科远股份	33,345,391.02	4.46
67	000793	华闻传媒	32,672,133.06	4.37
68	603108	润达医疗	32,400,693.17	4.33
69	002368	太极股份	32,374,311.42	4.33
70	601898	中煤能源	32,244,159.47	4.31
71	300130	新国都	32,120,421.90	4.30
72	002217	合力泰	31,892,774.59	4.26
73	600865	百大集团	30,833,740.80	4.12
74	300274	阳光电源	29,678,425.70	3.97
75	300027	华谊兄弟	29,456,209.32	3.94
76	600645	中源协和	29,036,120.00	3.88

77	300017	网宿科技	28,958,710.10	3.87
78	300212	易华录	28,774,669.98	3.85
79	002416	爱施德	28,018,289.90	3.75
80	002456	欧菲光	27,997,773.37	3.74
81	600521	华海药业	27,286,965.30	3.65
82	300013	新宁物流	27,186,370.50	3.64
83	300273	和佳股份	26,810,311.22	3.59
84	000801	四川九洲	26,330,712.94	3.52
85	300324	旋极信息	25,904,227.70	3.46
86	600028	中国石化	25,755,001.00	3.44
87	600172	黄河旋风	25,445,307.00	3.40
88	002426	胜利精密	25,130,226.00	3.36
89	600312	平高电气	25,092,306.96	3.36
90	600310	桂东电力	25,058,305.00	3.35
91	000997	新大陆	24,700,413.96	3.30
92	600279	重庆港九	24,134,961.42	3.23
93	000831	五矿稀土	24,087,040.00	3.22
94	002739	万达院线	23,739,385.86	3.17
95	002202	金风科技	23,710,887.74	3.17
96	600571	信雅达	23,640,247.00	3.16
97	600845	宝信软件	23,630,591.73	3.16
98	002173	千足珍珠	23,396,149.00	3.13
99	000712	锦龙股份	23,116,719.50	3.09
100	000858	五粮液	22,768,930.86	3.04
101	600637	东方明珠	22,575,507.86	3.02
102	002445	中南重工	22,278,079.64	2.98
103	002224	三力士	22,212,062.25	2.97
104	300018	中元华电	22,187,997.20	2.97
105	300140	启源装备	22,114,463.94	2.96
106	601398	工商银行	22,032,000.00	2.95
107	002055	得润电子	21,905,269.70	2.93
108	300011	鼎汉技术	21,765,865.90	2.91
109	000625	长安汽车	21,723,246.61	2.90
110	600120	浙江东方	21,660,729.73	2.90
111	000733	振华科技	21,589,756.24	2.89
112	600330	天通股份	21,184,440.39	2.83

113	300238	冠昊生物	21,160,917.56	2.83
114	600180	瑞茂通	21,087,769.00	2.82
115	002131	利欧股份	20,730,627.00	2.77
116	600415	小商品城	20,533,078.95	2.75
117	600118	中国卫星	20,330,974.30	2.72
118	600030	中信证券	20,250,524.00	2.71
119	600735	新华锦	20,219,500.00	2.70
120	300226	上海钢联	20,206,387.09	2.70
121	002667	鞍重股份	20,040,556.00	2.68
122	000797	中国武夷	20,037,713.90	2.68
123	600369	西南证券	19,818,917.70	2.65
124	002223	鱼跃医疗	19,663,821.89	2.63
125	002425	凯撒股份	19,590,319.99	2.62
126	000796	凯撒旅游	19,348,443.00	2.59
127	600270	外运发展	19,239,085.80	2.57
128	000829	天音控股	19,238,406.28	2.57
129	000971	高升控股	19,027,568.00	2.54
130	002344	海宁皮城	18,830,031.47	2.52
131	002657	中科金财	18,801,199.65	2.51
132	002383	合众思壮	18,679,342.48	2.50
133	300418	昆仑万维	18,417,520.00	2.46
134	002022	科华生物	18,340,014.94	2.45
135	002450	康得新	17,782,720.02	2.38
136	002348	高乐股份	17,746,677.00	2.37
137	600848	上海临港	17,479,562.93	2.34
138	000695	滨海能源	17,405,797.34	2.33
139	300086	康芝药业	17,259,293.80	2.31
140	300147	香雪制药	17,178,996.51	2.30
141	300159	新研股份	17,108,661.60	2.29
142	000514	渝开发	16,875,000.00	2.26
143	600829	人民同泰	16,801,076.82	2.25
144	002441	众业达	16,673,692.00	2.23
145	002081	金螳螂	16,431,558.71	2.20
146	002541	鸿路钢构	16,327,049.00	2.18
147	600185	格力地产	16,288,185.00	2.18
148	601766	中国中车	15,957,500.00	2.13

149	300295	三六五网	15,768,570.00	2.11
150	000681	视觉中国	15,553,700.75	2.08
151	000078	海王生物	15,424,806.01	2.06
152	600655	豫园商城	15,285,063.50	2.04
153	002546	新联电子	15,204,353.50	2.03
154	600628	新世界	15,188,087.00	2.03
155	600136	道博股份	15,074,856.80	2.02

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300104	乐视网	159,884,874.56	21.38
2	300059	东方财富	153,153,593.64	20.48
3	601166	兴业银行	131,712,048.48	17.61
4	002439	启明星辰	127,520,013.59	17.05
5	601318	中国平安	120,500,564.06	16.11
6	002714	牧原股份	118,279,311.06	15.82
7	300295	三六五网	117,633,271.20	15.73
8	600276	恒瑞医药	113,652,749.03	15.20
9	600588	用友网络	104,302,604.42	13.95
10	600570	恒生电子	95,845,263.34	12.82
11	000566	海南海药	94,155,276.98	12.59
12	600999	招商证券	88,319,750.41	11.81
13	002153	石基信息	80,699,020.80	10.79
14	000568	泸州老窖	77,370,565.19	10.35
15	600120	浙江东方	75,598,609.65	10.11
16	002250	联化科技	75,278,012.20	10.07
17	002466	天齐锂业	74,513,437.44	9.96
18	600048	保利地产	72,268,761.00	9.66
19	002292	奥飞动漫	71,609,752.73	9.58
20	002308	威创股份	67,730,868.68	9.06
21	601169	北京银行	65,967,341.17	8.82
22	601601	中国太保	65,149,372.50	8.71
23	002405	四维图新	64,445,680.30	8.62
24	600559	老白干酒	63,522,037.85	8.49
25	002285	世联行	62,768,324.68	8.39

26	002368	太极股份	62,251,682.62	8.32
27	300329	海伦钢琴	60,716,890.79	8.12
28	002354	天神娱乐	60,251,497.83	8.06
29	601628	中国人寿	59,526,258.84	7.96
30	002183	怡亚通	57,067,491.99	7.63
31	600109	国金证券	55,268,908.95	7.39
32	300005	探路者	55,067,018.18	7.36
33	600476	湘邮科技	54,251,755.38	7.25
34	600061	国投安信	53,294,422.52	7.13
35	600958	东方证券	52,171,318.75	6.98
36	300016	北陆药业	52,112,929.74	6.97
37	002135	东南网架	49,942,557.11	6.68
38	601988	中国银行	48,708,259.61	6.51
39	002717	岭南园林	47,283,070.85	6.32
40	601688	华泰证券	46,673,026.80	6.24
41	002675	东诚药业	46,308,988.02	6.19
42	000411	英特集团	44,601,909.34	5.96
43	603899	晨光文具	44,463,074.37	5.95
44	300244	迪安诊断	44,343,441.99	5.93
45	300010	立思辰	44,148,456.80	5.90
46	002658	雪迪龙	42,867,238.36	5.73
47	002699	美盛文化	42,746,902.50	5.72
48	300013	新宁物流	41,704,499.07	5.58
49	300392	腾信股份	40,851,927.92	5.46
50	300043	互动娱乐	40,804,297.60	5.46
51	300348	长亮科技	40,578,972.00	5.43
52	601336	新华保险	40,482,386.82	5.41
53	000002	万科A	39,493,304.24	5.28
54	002152	广电运通	39,399,063.68	5.27
55	002572	索菲亚	39,096,966.18	5.23
56	600029	南方航空	38,896,891.10	5.20
57	300017	网宿科技	38,651,758.30	5.17
58	600038	中直股份	38,558,031.63	5.16
59	002416	爱施德	38,464,410.28	5.14
60	300212	易华录	37,910,809.98	5.07
61	002400	省广股份	37,819,103.73	5.06
62	300203	聚光科技	36,508,714.00	4.88
63	603766	隆鑫通用	36,235,887.67	4.85

64	000001	平安银行	35,849,204.95	4.79
65	603108	润达医疗	35,642,736.55	4.77
66	000016	深康佳 A	35,491,072.13	4.75
67	002010	传化股份	33,587,217.50	4.49
68	000801	四川九洲	32,135,263.59	4.30
69	300253	卫宁健康	31,682,047.90	4.24
70	600016	民生银行	31,465,320.96	4.21
71	002456	欧菲光	31,120,940.91	4.16
72	002496	辉丰股份	30,977,471.96	4.14
73	002462	嘉事堂	30,673,885.89	4.10
74	601898	中煤能源	30,578,870.25	4.09
75	300027	华谊兄弟	29,547,882.73	3.95
76	300140	启源装备	29,416,568.47	3.93
77	600787	中储股份	29,195,498.94	3.90
78	300274	阳光电源	29,003,080.80	3.88
79	000733	振华科技	28,810,382.78	3.85
80	002224	三力士	28,485,059.13	3.81
81	002402	和而泰	28,403,790.63	3.80
82	300324	旋极信息	28,194,220.50	3.77
83	600172	黄河旋风	27,938,068.33	3.74
84	002739	万达院线	27,700,754.99	3.70
85	601818	光大银行	27,476,883.60	3.67
86	300273	和佳股份	26,752,521.96	3.58
87	600521	华海药业	26,280,595.46	3.51
88	300130	新国都	26,144,737.40	3.50
89	600645	中源协和	25,933,616.40	3.47
90	600735	新华锦	25,851,059.89	3.46
91	300018	中元华电	25,828,207.64	3.45
92	600312	平高电气	25,787,771.85	3.45
93	600415	小商品城	25,530,317.81	3.41
94	600310	桂东电力	25,462,425.92	3.40
95	600028	中国石化	25,400,000.00	3.40
96	600180	瑞茂通	25,028,846.50	3.35
97	000712	锦龙股份	24,946,792.29	3.34
98	000829	天音控股	24,893,627.45	3.33
99	002223	鱼跃医疗	24,831,812.80	3.32
100	002380	科远股份	24,350,399.51	3.26
101	600330	天通股份	24,025,433.92	3.21

102	002202	金风科技	23,657,805.20	3.16
103	600279	重庆港九	23,600,056.00	3.16
104	600571	信雅达	23,507,129.00	3.14
105	002445	中南重工	23,422,432.49	3.13
106	002373	千方科技	23,060,134.74	3.08
107	002049	同方国芯	22,858,861.94	3.06
108	601398	工商银行	22,280,663.00	2.98
109	000997	新大陆	22,178,624.71	2.97
110	600030	中信证券	22,042,750.50	2.95
111	000625	长安汽车	21,967,095.23	2.94
112	600754	锦江股份	21,534,521.26	2.88
113	000858	五粮液	21,517,376.93	2.88
114	002217	合力泰	21,395,157.00	2.86
115	000695	滨海能源	21,357,403.09	2.86
116	002344	海宁皮城	21,327,620.40	2.85
117	600271	航天信息	21,205,882.38	2.84
118	002425	凯撒股份	21,108,522.69	2.82
119	002450	康得新	20,911,101.36	2.80
120	002383	合众思壮	20,855,087.52	2.79
121	600118	中国卫星	20,674,875.24	2.76
122	300418	昆仑万维	20,237,833.65	2.71
123	000831	五矿稀土	19,884,368.28	2.66
124	000927	*ST夏利	19,679,555.96	2.63
125	600628	新世界	19,663,205.08	2.63
126	000796	凯撒旅游	18,660,231.14	2.50
127	002022	科华生物	18,581,771.31	2.48
128	002348	高乐股份	18,301,796.00	2.45
129	300271	华宇软件	18,216,766.06	2.44
130	300269	联建光电	18,072,211.71	2.42
131	600369	西南证券	18,055,582.70	2.41
132	600637	东方明珠	17,895,170.17	2.39
133	600100	同方股份	17,700,082.61	2.37
134	000797	中国武夷	17,603,638.68	2.35
135	000514	渝开发	17,409,213.58	2.33
136	603003	龙宇燃油	17,222,528.80	2.30
137	601766	中国中车	17,040,924.00	2.28
138	600750	江中药业	16,698,564.13	2.23
139	600978	宜华木业	16,518,122.23	2.21



140	002546	新联电子	16,367,240.00	2.19
141	600655	豫园商城	16,362,186.65	2.19
142	600829	人民同泰	16,274,995.28	2.18
143	002157	正邦科技	15,882,022.08	2.12
144	000925	众合科技	15,836,694.60	2.12
145	002541	鸿路钢构	15,800,951.93	2.11
146	600270	外运发展	15,683,074.84	2.10
147	002055	得润电子	15,468,947.50	2.07
148	002464	金利科技	15,334,380.00	2.05
149	000681	视觉中国	15,333,841.90	2.05
150	002568	百润股份	15,194,224.00	2.03
151	300088	长信科技	15,029,901.80	2.01
152	600690	青岛海尔	14,988,361.36	2.00

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,742,703,279.96
卖出股票收入（成交）总额	7,087,228,570.59

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,992,000.00	3.22
	其中：政策性金融债	39,992,000.00	3.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	39,992,000.00	3.22

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110219	11 国开 19	400,000	39,992,000.00	3.22

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金合同约定，无法投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同约定，无法投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,152,511.80
2	应收证券清算款	4,330,164.29
3	应收股利	-
4	应收利息	298,882.39
5	应收申购款	60,900.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,842,458.48

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,215	91,180.99	395,937,981.60	83.27%	79,570,868.64	16.73%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	290,197.23	0.0610%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年12月29日）基金份额总额	1,252,121,826.55
本报告期期初基金份额总额	465,709,849.33
本报告期基金总申购份额	394,974,717.49
减:本报告期基金总赎回份额	385,175,716.58
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	475,508,850.24

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、2015 年 8 月 21 日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于总经理离职及副总经理代行总经理职务的公告》，尤象都先生不再担任本公司总经理，由副总经理陈勇先生代为履行总经理职务。

二、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘会计师事务所，本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 80,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合	1	15,183,587,296.82	37.48%	4,607,490.04	36.89%	-
广发证券	1	14,186,209,893.46	30.27%	3,837,560.16	30.72%	-
齐鲁证券	1	12,774,966,170.69	20.07%	2,503,822.17	20.05%	-
银河证券	2	1,041,940,483.71	7.53%	953,802.26	7.64%	-
信达证券	1	641,869,744.15	4.64%	587,785.83	4.71%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

注：1、专用席位的选择标准和程序

选择证券公司专用席位的标准

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；
- (6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
华泰联合	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,140,319.95	58.35%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	1,527,999.00	41.65%	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，本基金自 2015 年 7 月 17 日起由股票型变更为混合型，基金更名为“银河创新成长混合型证券投资基金”，相应修改了基金的风险收益特征、基金合同和托管协议相关条款，并在指定媒体上公告。

银河基金管理有限公司  
2016 年 3 月 25 日